金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰元盛债券（LOF）
场内简称	金鹰元盛债券 LOF
基金主代码	162108
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
报告期末基金份额总额	36,622,821.10 份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置采用自上而下的投资视角，定性分析与定量分析并用，结合国内外政治经济环境、宏观政策、利率变化等，合理确定基金在普通债券、货币市场工具

	等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整本基金投资于普通债券、货币市场工具等资产的比例与期限结构。		
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金当中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、混合型基金、但高于货币市场基金。		
基金管理人	金鹰基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E	金鹰元盛债券（LOF）D
下属分级基金的交易代码	162108	004333	022146
报告期末下属分级基金的份额总额	15,125,152.13 份	21,323,272.58 份	174,396.39 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)		
	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E	金鹰元盛债券（LOF）D
1.本期已实现收益	-16,663.15	1,577.63	-323.52
2.本期利润	-139,279.18	-231,949.97	-2,462.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0089	-0.0085	-0.0105
4.期末基金资产净值	20,434,042.02	30,497,523.59	235,671.48

5.期末基金份额净值	1.3510	1.4302	1.3514

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

4、本基金自 2024 年 9 月 10 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2024 年 9 月 11 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰元盛债券（LOF）C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.65%	0.06%	1.07%	0.03%	-1.72%	0.03%
过去六个月	-0.18%	0.09%	2.27%	0.03%	-2.45%	0.06%
过去一年	-0.21%	0.11%	3.67%	0.04%	-3.88%	0.07%
过去三年	12.77%	0.19%	13.25%	0.07%	-0.48%	0.12%
过去五年	13.15%	0.17%	22.36%	0.07%	-9.21%	0.10%
过去七年	26.38%	0.15%	32.54%	0.07%	-6.16%	0.08%
过去十年	35.05%	0.14%	46.26%	0.07%	-11.21%	0.07%
自基金合同生效起至今	49.63%	0.14%	59.82%	0.07%	-10.19%	0.07%

金鹰元盛债券（LOF）E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.55%	0.06%	1.07%	0.03%	-1.62%	0.03%
过去六个月	0.02%	0.09%	2.27%	0.03%	-2.25%	0.06%

过去一年	0.20%	0.11%	3.67%	0.04%	-3.47%	0.07%
过去三年	14.14%	0.19%	13.25%	0.07%	0.89%	0.12%
过去五年	15.53%	0.17%	22.36%	0.07%	-6.83%	0.10%
过去七年	30.49%	0.15%	32.54%	0.07%	-2.05%	0.08%
自基金合同生效起至今	56.59%	0.22%	49.46%	0.07%	7.13%	0.15%

金鹰元盛债券（LOF）D

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.65%	0.06%	1.07%	0.03%	-1.72%	0.03%
过去六个月	-0.24%	0.09%	2.27%	0.03%	-2.51%	0.06%
过去一年	-0.38%	0.11%	3.67%	0.04%	-4.05%	0.07%
自基金合同生效起至今	11.50%	0.19%	6.29%	0.08%	5.21%	0.11%

注：本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

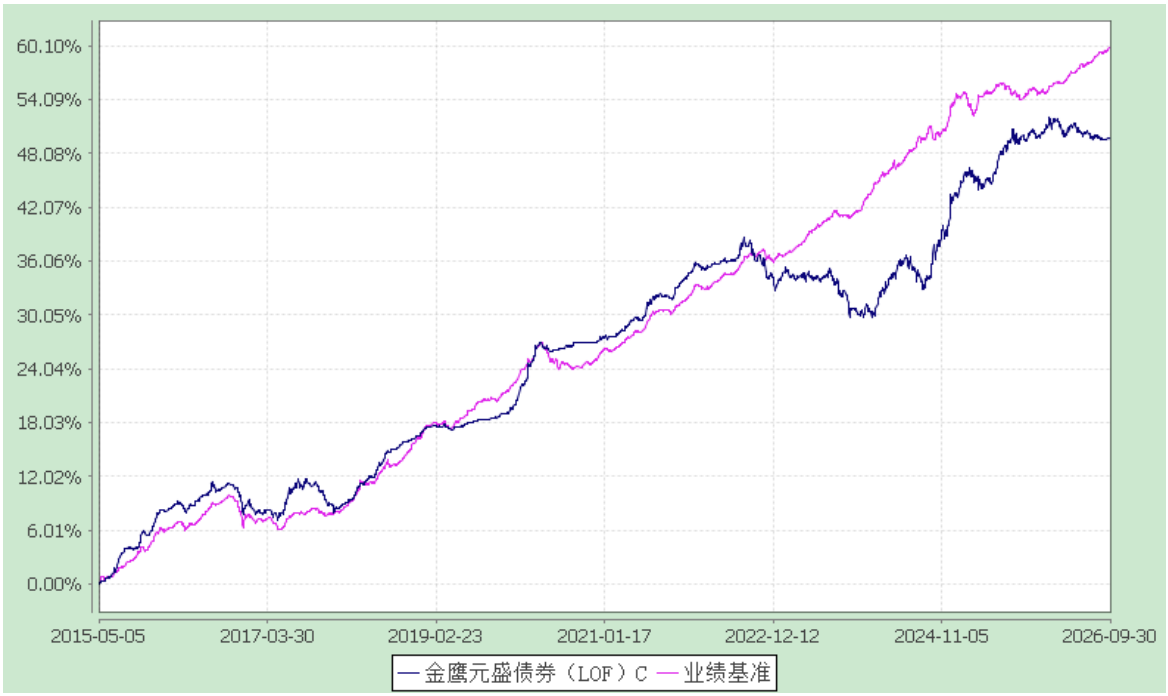
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

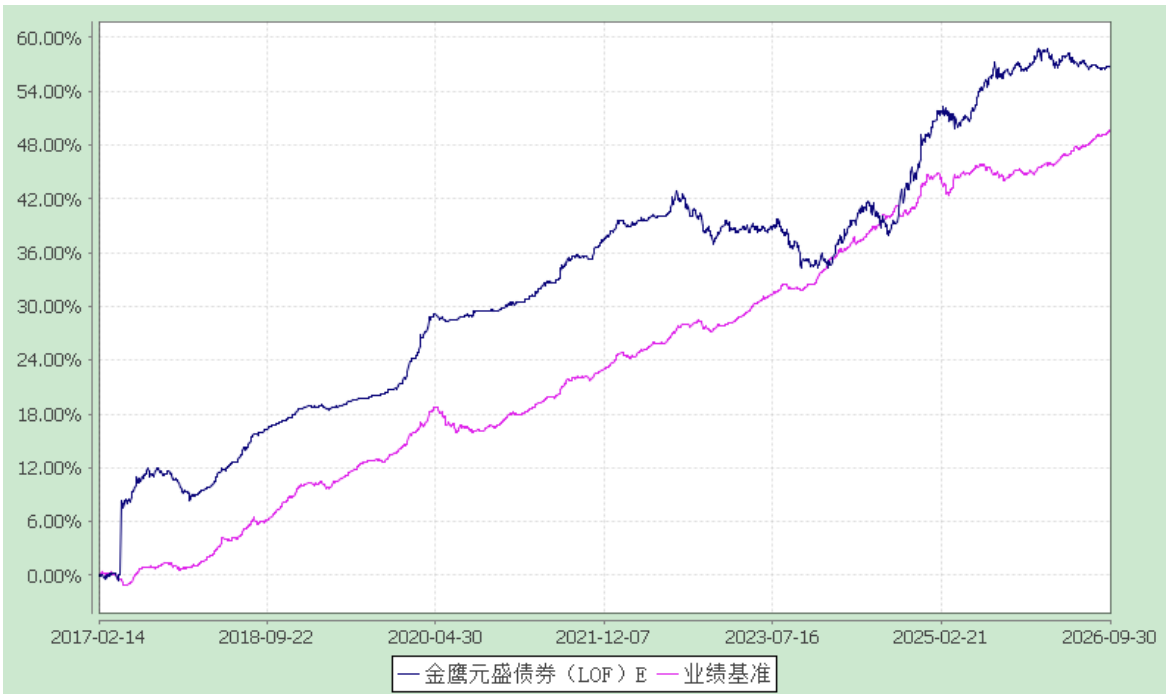
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015 年 5 月 5 日至 2026 年 9 月 30 日）

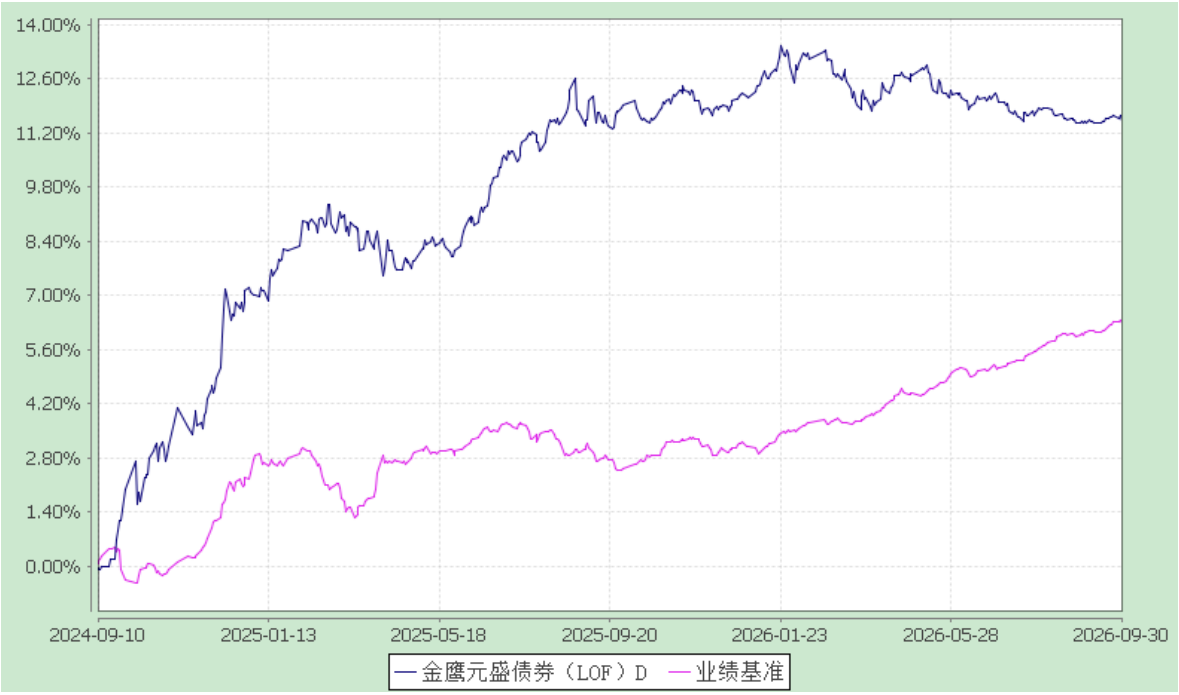
金鹰元盛债券（LOF）C



金鹰元盛债券（LOF）E



金鹰元盛债券（LOF）D



注：（1）本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率；

（2）本基金自 2015 年 5 月 5 日起转型，E 类基金份额于 2017 年 2 月 14 日设立；

（3）本基金自 2024 年 9 月 10 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2024 年 9 月 11 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王怀震	本基金的基金经理，公司总经理助理、混合投资部总经理	2022-10-20	-	22	王怀震先生，山东大学经济学硕士。曾任新疆证券有限责任公司研究所行业研究员，浙商银行股份有限公司债券交易员，招商证券股份有限公司投资经理，银华基金管理股份有限公司基金经理，歌斐诺宝资产管理公司总经理助理，嘉实基金管理有限公司投资经理，招商

					信诺资产管理有限公司副总经理。2022 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司,现任总经理助理兼混合投资部总经理、基金经理。
许浩琨	本基金的基金经理	2024-05-17	-	9	许浩琨先生,伊利诺伊大学香槟分校经济学硕士。曾任中国出口信用保险公司资产管理部研究分析处职员、天弘基金管理有限公司中央交易室债券研究员及固定收益部研究员、光大理财管理有限公司固定收益部职员。2023 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司,曾任混合投资部基金经理助理,现任混合投资部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金基金合同等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确

保公平交易的实施。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济压力有所增加，并呈现外需强内需走弱的特征，投资和消费在三季度有一定程度下滑，出口端仍保持韧性。通胀方面，美伊反复，石油和成品油价格高位，通胀一定程度向国内传导，但核心通胀受制于薪资等因素仍然较弱。政策端，地产政策适度放宽，但总量政策仍然保持一定定力。

债券端，三季度经济承压，且债券发行量并未大幅提速，尽管货币当局强调防止债券收益快速下行，资金利率有所波动，但资金整体仍然保持宽松，同时权益市场承压，债券资金净申购有所增加，债券收益率三季度下行。

转债市场，三季度转债市场受股票市场影响，转债整体风格跟随股票，电子、通讯等与 AI 相关转债下跌，科技板块转债回撤幅度较大，风格上低价好于高价。

具体到组合上，本基金债券投资以利率债为主，三季度适度提高久期，通过长端进行波段操作，增厚收益。转债方面三季度适度降低转债仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 C 类份额净值为 1.3510 元，本报告期份额净值收益率为-0.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；E 类份额净值为 1.4302 元，本报告期份额净值收益率为-0.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；D 类份额净值为 1.3514 元，本报告期份额净值收益率为-0.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应当说明的预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	50,373,041.72	94.13
	其中：债券	50,373,041.72	94.13
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-487.12	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,132,456.28	2.12
7	其他资产	2,008,981.72	3.75
8	合计	53,513,992.60	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	14,683,497.63	28.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,965,583.56	60.52
	其中：政策性金融债	30,965,583.56	60.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,723,960.53	9.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,373,041.72	98.45

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	240203	24 国开 03	200,000.00	20,692,520.55	40.44
2	230208	23 国开 08	100,000.00	10,273,063.01	20.08
3	019776	25 特国 02	55,000.00	5,288,192.74	10.34
4	019792	25 国债 19	40,000.00	4,053,882.74	7.92
5	019846	26 国债 14	20,000.00	2,002,573.15	3.91

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,967.81
2	应收证券清算款	2,000,556.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	457.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,008,981.72

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113633	科沃转债	888,519.44	1.74
2	127025	冀东转债	813,960.16	1.59
3	113052	兴业转债	801,324.49	1.57
4	113049	长汽转债	671,077.12	1.31

5	110085	通 22 转债	469,181.44	0.92
6	123117	健帆转债	331,689.12	0.65
7	123158	宙邦转债	174,639.80	0.34
8	118030	睿创转债	171,139.87	0.33
9	127083	山路转债	162,123.85	0.32
10	118056	路维转债	127,619.10	0.25
11	113638	台 21 转债	112,686.14	0.22

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E	金鹰元盛债券（LOF）D
报告期期初基金份额总额	16,060,173.96	31,695,453.86	304,752.47
报告期期间基金总申购份额	96,785.79	35,782.82	317.35
减：报告期期间基金总赎回份额	1,031,807.62	10,407,964.10	130,673.43
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	15,125,152.13	21,323,272.58	174,396.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无交易。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起人的三年封闭期限已经届满。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

1、中国证监会批准发行及募集的文件。

2、《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》。

3、《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2存放地点

广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

10.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日